

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	75
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	75
§ 10 开放式基金份额变动	75
§ 11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	80
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§ 13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500 指数增强
场内简称	无
基金主代码	006682
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	866,145,776.72 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	1、资产配置策略 本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。 2、股票投资策略 本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。 3、债券投资策略 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。 4、权证、股指期货投资策略 本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。 本基金对权证的分析判断主要从市场环境、时机、权证定价、市场供求、发行人资质、交易冲击等方面综合考量，运用权证定价模型计算权证当前的合理价格。本基金适时选择具有相对优势的权证并制定相应的投资计划。

	本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 5、中小企业私募债券的投资策略 对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66596688
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		李进	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	103,016,728.62	180,685,167.13	-63,748,773.17
本期利润	100,830,275.82	134,721,153.18	-9,239,745.41
加权平均基金份额本期利润	0.1836	0.3255	-0.0073
本期加权平均净值利润率	11.58%	29.87%	-0.76%
本期基金份额净值增长率	22.27%	34.43%	-0.71%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	547,468,846.68	66,840,598.90	-57,856,637.67
期末可供分配基金份额利润	0.6321	0.3348	-0.0537
期末基金资产净值	1,413,614,623.40	266,471,291.11	1,070,707,106.44
期末基金份额净值	1.6320	1.3348	0.9929
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	63.20%	33.48%	-0.71%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

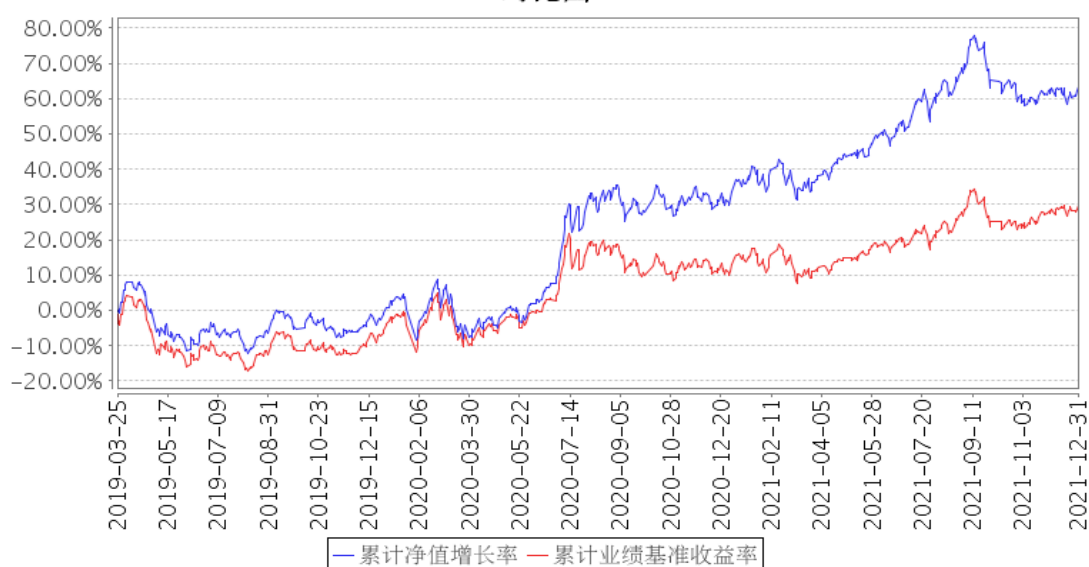
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.18%	0.75%	3.43%	0.72%	-4.61%	0.03%

过去六个月	6.21%	0.98%	7.72%	0.91%	-1.51%	0.07%
过去一年	22.27%	0.98%	14.83%	0.92%	7.44%	0.06%
自基金合同生效起至今	63.20%	1.29%	29.60%	1.28%	33.60%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

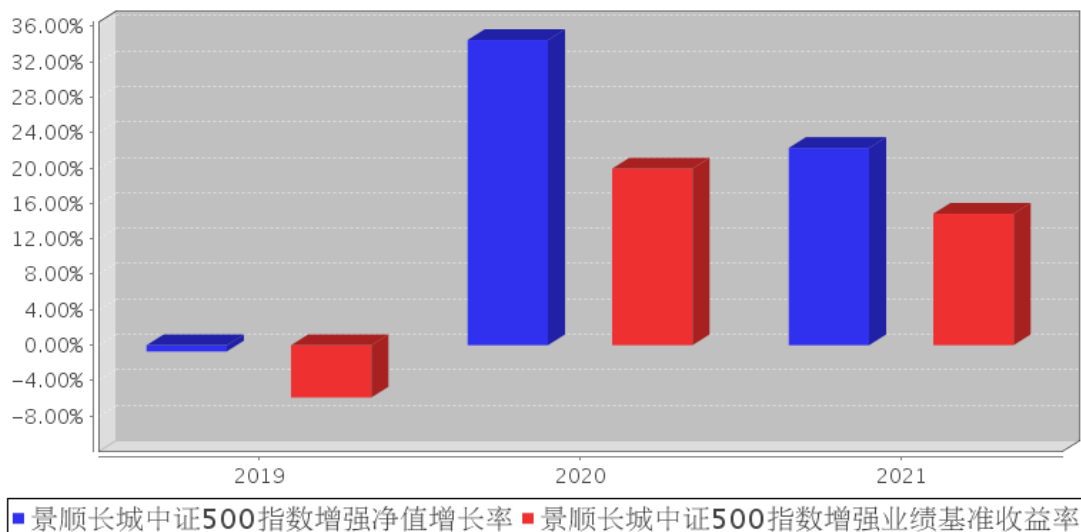
景顺长城中证500指数增强累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2019 年 3 月 25 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证500指数增强基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2019 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2019年3月25日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003] 76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2021 年 12 月 31 日，本公司旗下共管理 140 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产

配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	本基金的基金经理	2019 年 3 月 25 日	-	18 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 18 年海内外证券、基金行业从业经验。
徐喻军	本基金的基金经理	2019 年 3 月 25 日	-	11 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 11 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律

法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、

5 日内) 公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析, 对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释, 由投资组合经理、督察长、总经理签署后, 妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内, 公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况, 应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制, 针对潜在问题完善公平交易制度, 并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011 年修订)》, 完善相应制度及流程, 通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行, 公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011 年修订)》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析, 未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内, 本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价, 同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 25 次, 为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易, 按规定履行了审批程序。

本报告期内, 未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年, 受出口超预期增长、新动能不断增强和上半年低基数等因素的影响, 中国经济稳定回升, 全年呈现前高后低走势。全年 GDP 增长 8.1%, 工业增加值累计增长 9.6%。12 月 PMI 指数 50.3, 景气指数企稳回升。12 月 PPI 同比上涨 10.3%, 环比下降 2.6%; 12 月 CPI 同比上涨 1.5%, 环比下降 0.8%。12 月 M2 同比增速 9%, M1 同比增速 3.5%, 全年社会融资规模存量同比增长 10.29%。12 月末外汇储备 3.25 万亿美元, 汇率保持基本稳定。

2021 年上半年, 超预期强势的出口和极具韧性的房地产投资对经济形成有力支撑。下半年以来, 出口以及房地产投资的情况均出现了明显变化, 经济面临一定的下行压力。受疫情持续反复及居民收入增长乏力等因素影响, 国内消费疲弱, 12 月社会消费品零售总额同比增长 1.7%, 增速尚未恢复到疫情前水平。信用环境仍偏弱, 政策层面宽信用的意图比较明确, 货币政策方面也通过全面降准、多种结构性工具进行配合。2021 年全年 A 股市场呈现出结构性分化行情, 沪深 300

指数下跌 5.2%，中证 500 和创业板指分别上涨 15.58%、12.02%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年度，本基金份额净值增长率为 22.27%，业绩比较基准收益率为 14.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，海外流动性拐点临近、通胀压力仍在，外需大概率将走弱，需要警惕美股波动以及美元走高对于新兴市场的冲击。国内经济可能要面临内外需同时走弱风险，经济扩张动能减弱的趋势或将维持。PPI-CPI 的剪刀差将明显收窄，中下游盈利能力有望得到边际修复。为了稳定增长，货币、信用进入新一轮宽松周期，但预计整体扩张力度较温和，信用分化、结构性扩张的格局将延续。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。权益市场仍具备结构性配置机会，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金是以中证 500 指数为基准的指数增强基金，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和

临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员

会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60467014_H32 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

	治理层负责监督景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌华	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2022 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	120,723,773.86	22,779,050.57
结算备付金		10,833,524.99	1,051,834.97
存出保证金		2,545,155.35	116,276.33
交易性金融资产	7.4.7.2	1,317,771,777.10	250,067,992.70
其中：股票投资		1,317,708,777.10	250,067,992.70
基金投资		-	-
债券投资		63,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	550,621.30
应收利息	7.4.7.5	13,803.94	2,317.50
应收股利		-	-
应收申购款		4,574,421.33	237,595.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,456,462,456.57	274,805,688.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		25,146,583.93	-
应付赎回款		10,037,443.56	7,127,556.25
应付管理人报酬		1,506,353.29	276,519.78
应付托管费		251,058.91	46,086.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,606,021.21	587,430.23
应交税费		0.98	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	300,371.29	296,804.99
负债合计		42,847,833.17	8,334,397.88
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	866,145,776.72	199,630,692.21
未分配利润	7.4.7.10	547,468,846.68	66,840,598.90
所有者权益合计		1,413,614,623.40	266,471,291.11
负债和所有者权益总计		1,456,462,456.57	274,805,688.99

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.6320 元，基金份额总额 866,145,776.72 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		130,095,382.54	149,041,504.47
1. 利息收入		329,203.46	201,058.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	328,524.61	200,795.02
债券利息收入		678.85	263.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		127,675,075.71	193,196,955.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	116,002,745.01	187,518,813.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	332,948.26	477,941.76
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,423,271.20	-
股利收益	7.4.7.15	9,916,111.24	5,200,200.29
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,186,452.80	-45,964,013.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,277,556.17	1,607,504.79
减：二、费用		29,265,106.72	14,320,351.29
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,380,433.11	5,500,614.08

2. 托管费	7.4.10.2.2	1,730,072.09	916,769.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	16,680,593.16	7,502,504.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		9,457.72	0.96
7. 其他费用	7.4.7.19	464,550.64	400,462.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		100,830,275.82	134,721,153.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		100,830,275.82	134,721,153.18

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	199,630,692.21	66,840,598.90	266,471,291.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	100,830,275.82	100,830,275.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	666,515,084.51	379,797,971.96	1,046,313,056.47
其中：1. 基金申购款	1,460,924,998.43	859,460,584.45	2,320,385,582.88
2. 基金赎回款	-794,409,913.92	-479,662,612.49	-1,274,072,526.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	866,145,776.72	547,468,846.68	1,413,614,623.40
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,078,300,882.08	-7,593,775.64	1,070,707,106.44

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	134,721,153.18	134,721,153.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-878,670,189.87	-60,286,778.64	-938,956,968.51
其中：1. 基金申购款	160,942,020.36	22,669,361.45	183,611,381.81
2. 基金赎回款	-1,039,612,210.23	-82,956,140.09	-1,122,568,350.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	199,630,692.21	66,840,598.90	266,471,291.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1897 号文《关于准予景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2019 年 3 月 25 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,507,912,000.78 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 967,567.93 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,508,879,568.71 元，折合 1,508,879,568.71 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，

但须符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2022 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

(2) 金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债，按取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；

保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按其估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用相关可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体

情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和标的指数许可使用费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的相关交易费用在发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额计入当期费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

(2) 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服

务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	120,723,773.86	22,779,050.57
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-	-
存款期限 1 年（含）以上	-	-
其他存款	-	-
合计	120,723,773.86	22,779,050.57

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,311,965,736.09	1,317,708,777.10	5,743,041.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	63,000.00	63,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	63,000.00	63,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,312,028,736.09	1,317,771,777.10	5,743,041.01
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		241,522,978.89	250,067,992.70	8,545,013.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		241,522,978.89	250,067,992.70	8,545,013.81

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	14,611,600.00	-	-	
其中：股指期货投资	14,611,600.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	14,611,600.00	-	-	
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：1：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为期末的合约价值。

2：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。本报告期末本基金投资的股指期货持仓明细如下：

合约代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动
		买/（卖）	人民币元	人民币元
IC2203	中证 500 指数期货 2203	10	14,611,600.00	615,520.00
总额合计	-	10	14,611,600.00	615,520.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	615,520.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,889.35	1,791.90
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	4,679.85	473.30
应收债券利息	9.94	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	224.80	52.30
合计	13,803.94	2,317.50

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末的其他资产余额为零。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	5,606,021.21	587,430.23
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	5,606,021.21	587,430.23

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	18,373.94	16,804.99

应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	180,000.00
应付指数使用费	61,997.35	100,000.00
合计	300,371.29	296,804.99

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	199,630,692.21	199,630,692.21
本期申购	1,460,924,998.43	1,460,924,998.43
本期赎回（以“-”号填列）	-794,409,913.92	-794,409,913.92
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	866,145,776.72	866,145,776.72

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	85,048,841.74	-18,208,242.84	66,840,598.90
本期利润	103,016,728.62	-2,186,452.80	100,830,275.82
本期基金份额交易产生的变动数	403,466,141.56	-23,668,169.60	379,797,971.96
其中：基金申购款	911,382,012.84	-51,921,428.39	859,460,584.45
基金赎回款	-507,915,871.28	28,253,258.79	-479,662,612.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	591,531,711.92	-44,062,865.24	547,468,846.68

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	229,627.34	170,369.87
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	95,345.57	25,614.09
其他	3,551.70	4,811.06
合计	328,524.61	200,795.02

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	5,150,686,791.52	2,746,511,008.48
减：卖出股票成本总额	5,034,684,046.51	2,558,992,195.23
买卖股票差价收入	116,002,745.01	187,518,813.25

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,663,622.50	2,335,730.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,330,000.00	1,857,500.00
减：应收利息总额	674.24	288.61
买卖债券差价收入	332,948.26	477,941.76

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	1,423,271.20	-

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	9,916,111.24	5,200,200.29
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	9,916,111.24	5,200,200.29

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
------	--	---

1. 交易性金融资产	-2,801,972.80	-45,964,013.95
股票投资	-2,801,972.80	-45,964,013.95
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	615,520.00	-
权证投资	-	-
股指期货投资	615,520.00	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-2,186,452.80	-45,964,013.95

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	3,869,318.34	1,551,755.16
基金转换费收入	408,237.83	55,749.63
合计	4,277,556.17	1,607,504.79

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	16,680,593.16	7,502,504.71
银行间市场交易费用	-	-
合计	16,680,593.16	7,502,504.71

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	32,553.29	20,462.43
指数使用费	211,997.35	200,000.00
合计	464,550.64	400,462.43

7.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
长城证券	1,622,534,315.23	14.46	7,084,470.99	0.16

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	1,511,063.44	14.49	1,222,994.80	21.82
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	6,597.70	0.16	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,380,433.11	5,500,614.08
其中：支付销售机构的客户维护费	2,297,377.37	1,857,596.46

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,730,072.09	916,769.11

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外,本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	120,723,773.86	229,627.34	22,779,050.57	170,369.87

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管,并按银行间同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 16 日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流 通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股流 通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	新股流 通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	新股流 通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股流 通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股流 通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股流 通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股流 通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 17 日	新股流 通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股流 通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	新股流 通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流 通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股流 通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	新股流 通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股流 通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-

		日	日							
301058	中粮 工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股流 通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301060	兰卫 医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股流 通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海 艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	新股流 通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301066	万事 利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	新股流 通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地 海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流 通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301073	君亭 酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股流 通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳 液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股流 通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌 股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	新股流 通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛 电气	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 27 日	新股流 通受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜 智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	新股流 通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚 医疗	2021 年 10 月 15 日	2022 年 4 月 25 日	新股流 通受限	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-
301088	戎美 股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 28 日	新股流 通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301092	争光 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股流 通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股流 通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚	2021 年	2022 年	新股流	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-

	医药	12月13日	6月20日	通受限						
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股流通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股流通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股流通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股流通受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股流通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-

301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	新股流 通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股流 通受限	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股流 通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	新股流 通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	新股流 通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	新股流 通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301189	奥尼电子	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股流 通受限	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股流 通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 9 日	新股流 通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 2 日	新股流 通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股流 通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021 年 12 月 14 日	2022 年 6 月 22 日	新股流 通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	新股流 通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
688032	禾迈股份	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	新股流 通受限	557.80	650.66	1,508	841,162.40	981,195.28	-
688049	炬芯科技	2021 年 11 月 22 日	2022 年 5 月 30 日	新股流 通受限	42.98	51.71	3,260	140,114.80	168,574.60	-

		日	日							
688121	卓然股份	2021 年 8 月 30 日	2022 年 3 月 7 日	新股流通受限	18.16	36.42	3,681	66,846.96	134,062.02	-
688151	华强科技	2021 年 11 月 29 日	2022 年 6 月 6 日	新股流通受限	35.09	33.82	12,238	429,431.42	413,889.16	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 7 月 6 日	新股流通受限	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688622	禾信仪器	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-
688728	格科微	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 18 日	新股流通受限	14.38	29.31	23,033	331,214.54	675,097.23	-
688778	厦钨新能	2021 年 7 月 29 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	24.50	100.74	5,075	124,337.50	511,255.50	-
688798	艾为电子	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 16 日	新股流通受限	76.58	210.33	3,592	275,075.36	755,505.36	-
871245	威博液压	2021 年 12 月 24 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.68	9.68	200	1,936.00	1,936.00	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113634	珀莱转债	2021 年 12 月 9 日	2022 年 1 月 4 日	新债流通受限	100.00	100.00	630	63,000.00	63,000.00	-

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终可流通日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.00%（上年度末：0.00%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	120,723,773.86	-	-	-	-	-	120,723,773.86
结算备付金	10,833,524.99	-	-	-	-	-	10,833,524.99
存出保证金	499,531.35	-	-	-	-	2,045,624.00	2,545,155.35
交易性金融资产	-	-	-	-	63,000.00	1,317,708,777.10	1,317,771,777.10
应收利息	-	-	-	-	-	13,803.94	13,803.94
应收申购款	-	-	-	-	-	4,574,421.33	4,574,421.33
资产总计	132,056,830.20	-	-	-	63,000.00	1,324,342,626.37	1,456,462,456.57
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,037,443.56	10,037,443.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,506,353.29	1,506,353.29
应付托管费	-	-	-	-	-	251,058.91	251,058.91
应付证券清算款	-	-	-	-	-	25,146,583.93	25,146,583.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,606,021.21	5,606,021.21
应交税费	-	-	-	-	-	0.98	0.98

其他负债	-	-	-	-	-	300,371.29	300,371.29
负债总计	-	-	-	-	-	42,847,833.17	42,847,833.17
利率敏感度缺口	132,056,830.20	-	-	-	63,000.00	-	-
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	22,779,050.57	-	-	-	-	-	22,779,050.57
结算备付金	1,051,834.97	-	-	-	-	-	1,051,834.97
存出保证金	116,276.33	-	-	-	-	-	116,276.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	250,067,992.70	250,067,992.70
应收利息	-	-	-	-	-	2,317.50	2,317.50
应收申购款	-	-	-	-	-	237,595.62	237,595.62
应收证券清算款	-	-	-	-	-	550,621.30	550,621.30
资产总计	23,947,161.87	-	-	-	-	250,858,527.12	274,805,688.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,127,556.25	7,127,556.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	276,519.78	276,519.78
应付托管费	-	-	-	-	-	46,086.63	46,086.63
应付交易费用	-	-	-	-	-	587,430.23	587,430.23
其他负债	-	-	-	-	-	296,804.99	296,804.99
负债总计	-	-	-	-	-	8,334,397.88	8,334,397.88
利率敏感度缺口	23,947,161.87	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,317,708,777.10	93.22	250,067,992.70	93.84
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,317,708,777.10	93.22	250,067,992.70	93.84

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	44,673,178.93	13,388,040.37
	沪深 300 指数下降 5%	-44,673,178.93	-13,388,040.37

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

(1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划

分为第一层次的余额为人民币 1,312,562,361.92 元，划分为第二层次的余额为人民币 5,209,415.18 元，无划分为第三层次的余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 247,123,404.76 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,944,587.94 元，无划分为第三层次的余额）。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本报告期无净转入（转出）第三层次。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会[2017]7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会[2017]8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会[2017]9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会[2017]14 号)（以上统称新金融工具相关会计准则），以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(3) 除上述事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,317,708,777.10	90.47
	其中：股票	1,317,708,777.10	90.47
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	63,000.00	0.00
	其中：债券	63,000.00	0.00
	资产支持证券	—	—

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	131,557,298.85	9.03
8	其他各项资产	7,133,380.62	0.49
9	合计	1,456,462,456.57	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	35,485,660.41	2.51
C	制造业	719,556,092.46	50.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,991,672.28	3.18
E	建筑业	11,643,068.00	0.82
F	批发和零售业	19,958,717.83	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	27,506,304.00	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,165,156.04	4.47
J	金融业	67,383,513.24	4.77
K	房地产业	42,055,304.30	2.98
L	租赁和商务服务业	10,320,800.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	3,543,701.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,511,169.62	1.03
R	文化、体育和娱乐业	33,246,487.68	2.35
S	综合	12,149,616.00	0.86
	合计	1,105,517,262.86	78.20

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,934,118.00	0.63
C	制造业	141,734,372.65	10.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,637,492.00	0.19
E	建筑业	9,013,537.99	0.64
F	批发和零售业	170,989.16	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,405,082.00	0.38
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,979,805.19	0.64

J	金融业	21,798,417.85	1.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,350,765.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	70,990.98	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	50,198.91	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,985,624.20	0.14
R	文化、体育和娱乐业	7,055,512.31	0.50
S	综合	-	-
	合计	212,191,514.24	15.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600885	宏发股份	442,800	33,050,592.00	2.34
2	600373	中文传媒	2,434,413	30,089,344.68	2.13
3	000060	中金岭南	6,064,721	29,777,780.11	2.11
4	600487	亨通光电	1,873,100	28,321,272.00	2.00
5	601598	中国外运	6,139,800	27,506,304.00	1.95
6	002156	通富微电	1,380,282	26,818,879.26	1.90
7	300037	新宙邦	230,600	26,057,800.00	1.84
8	002396	星网锐捷	1,077,960	25,407,517.20	1.80
9	600008	首创环保	6,349,040	21,650,226.40	1.53
10	000039	中集集团	1,258,960	21,603,753.60	1.53
11	000988	华工科技	752,800	20,973,008.00	1.48
12	601555	东吴证券	2,342,514	20,754,674.04	1.47
13	600325	华发股份	3,357,900	20,214,558.00	1.43
14	601699	潞安环能	1,765,190	19,964,298.90	1.41
15	600282	南钢股份	5,352,282	19,803,443.40	1.40
16	002557	洽洽食品	303,724	18,636,504.64	1.32
17	600765	中航重机	358,900	18,120,861.00	1.28
18	601128	常熟银行	2,522,300	16,672,403.00	1.18
19	600546	山煤国际	1,957,623	16,072,084.83	1.14
20	603444	吉比特	37,031	15,621,527.35	1.11
21	600271	航天信息	1,148,779	15,382,150.81	1.09
22	000932	华菱钢铁	2,978,500	15,220,135.00	1.08
23	300244	迪安诊断	432,266	14,511,169.62	1.03

24	000598	兴蓉环境	2,249,337	14,215,809.84	1.01
25	300253	卫宁健康	834,732	13,990,108.32	0.99
26	603456	九洲药业	244,608	13,761,646.08	0.97
27	600597	光明乳业	942,500	13,685,100.00	0.97
28	000960	锡业股份	698,349	13,638,755.97	0.96
29	002185	华天科技	1,064,400	13,528,524.00	0.96
30	000656	金科股份	2,940,800	13,174,784.00	0.93
31	300363	博腾股份	144,700	12,943,415.00	0.92
32	000987	越秀金控	1,456,136	12,668,383.20	0.90
33	603927	中科软	462,050	12,641,688.00	0.89
34	600782	新钢股份	2,289,200	12,086,976.00	0.86
35	601689	拓普集团	215,500	11,421,500.00	0.81
36	600808	马钢股份	3,016,300	11,130,147.00	0.79
37	688005	容百科技	93,693	10,829,036.94	0.77
38	600908	无锡银行	1,895,500	10,747,485.00	0.76
39	000009	中国宝安	720,800	10,401,144.00	0.74
40	600862	中航高科	289,700	10,359,672.00	0.73
41	600415	小商品城	2,128,000	10,320,800.00	0.73
42	600529	山东药玻	233,500	10,250,650.00	0.73
43	002223	鱼跃医疗	269,534	10,188,385.20	0.72
44	600038	中直股份	124,400	9,989,320.00	0.71
45	002508	老板电器	271,028	9,762,428.56	0.69
46	600141	兴发集团	251,100	9,511,668.00	0.67
47	300751	迈为股份	14,553	9,347,391.90	0.66
48	600256	广汇能源	1,400,900	9,161,886.00	0.65
49	600803	新奥股份	497,039	9,125,636.04	0.65
50	000733	振华科技	72,500	9,010,300.00	0.64
51	002831	裕同科技	258,600	8,712,234.00	0.62
52	603605	珀莱雅	41,500	8,644,865.00	0.61
53	600867	通化东宝	756,700	8,293,432.00	0.59
54	603613	国联股份	75,881	8,157,207.50	0.58
55	605358	立昂微	67,800	8,136,678.00	0.58
56	600298	安琪酵母	130,700	7,889,052.00	0.56
57	603712	七一二	177,038	7,665,745.40	0.54
58	600201	生物股份	465,300	7,607,655.00	0.54
59	300223	北京君正	56,100	7,517,400.00	0.53
60	000825	太钢不锈	1,061,300	7,471,552.00	0.53
61	002439	启明星辰	255,101	7,278,031.53	0.51
62	600549	厦门钨业	293,954	6,652,179.02	0.47
63	600563	法拉电子	28,300	6,576,920.00	0.47
64	600764	中国海防	158,100	6,428,346.00	0.45
65	002430	杭氧股份	201,100	6,035,011.00	0.43

66	688006	杭可科技	56,069	6,031,903.02	0.43
67	000830	鲁西化工	393,000	5,997,180.00	0.42
68	002028	思源电气	116,600	5,737,886.00	0.41
69	000990	诚志股份	356,355	5,637,536.10	0.40
70	000636	风华高科	189,000	5,632,200.00	0.40
71	002985	北摩高科	46,520	5,603,799.20	0.40
72	000999	华润三九	162,200	5,553,728.00	0.39
73	601636	旗滨集团	324,439	5,547,906.90	0.39
74	002465	海格通信	493,900	5,393,388.00	0.38
75	000519	中兵红箭	198,200	5,285,994.00	0.37
76	002375	亚厦股份	692,200	5,184,578.00	0.37
77	600329	中新药业	157,400	4,943,934.00	0.35
78	000959	首钢股份	843,600	4,833,828.00	0.34
79	600372	中航电子	215,726	4,830,105.14	0.34
80	601717	郑煤机	388,200	4,499,238.00	0.32
81	600064	南京高科	479,645	4,479,884.30	0.32
82	600970	中材国际	391,000	4,469,130.00	0.32
83	000050	深天马 A	340,489	4,433,166.78	0.31
84	002244	滨江集团	898,300	4,186,078.00	0.30
85	002701	奥瑞金	567,500	3,972,500.00	0.28
86	300474	景嘉微	23,900	3,637,580.00	0.26
87	603127	昭衍新药	30,700	3,543,701.00	0.25
88	300630	普利制药	64,000	3,522,560.00	0.25
89	600705	中航产融	868,100	3,446,357.00	0.24
90	600392	盛和资源	166,900	3,274,578.00	0.23
91	002690	美亚光电	84,300	3,157,878.00	0.22
92	601098	中南传媒	329,900	3,157,143.00	0.22
93	002048	宁波华翔	144,601	3,127,719.63	0.22
94	600901	江苏租赁	607,900	3,094,211.00	0.22
95	000887	中鼎股份	137,900	3,007,599.00	0.21
96	600315	上海家化	71,000	2,869,110.00	0.20
97	000630	铜陵有色	807,800	2,811,144.00	0.20
98	600522	中天科技	157,300	2,667,808.00	0.19
99	601168	西部矿业	194,900	2,652,589.00	0.19
100	002408	齐翔腾达	230,800	2,423,400.00	0.17
101	600511	国药股份	75,500	2,380,515.00	0.17
102	003022	联泓新科	64,100	2,335,804.00	0.17
103	600536	中国软件	46,400	2,316,752.00	0.16
104	300136	信维通信	86,400	2,187,648.00	0.15
105	000983	山西焦煤	249,213	2,060,991.51	0.15
106	600170	上海建工	552,600	1,989,360.00	0.14
107	300418	昆仑万维	82,400	1,907,560.00	0.13

108	000513	丽珠集团	43,800	1,761,198.00	0.12
109	600673	东阳光	196,900	1,748,472.00	0.12
110	600699	均胜电子	76,300	1,676,311.00	0.12
111	603290	斯达半导	4,200	1,600,200.00	0.11
112	600516	方大炭素	130,800	1,415,256.00	0.10
113	002434	万里扬	77,400	1,140,876.00	0.08
114	002056	横店东磁	53,500	1,009,545.00	0.07
115	300296	利亚德	96,800	992,200.00	0.07
116	002416	爱施德	80,100	911,538.00	0.06
117	600348	华阳股份	70,200	831,870.00	0.06
118	688188	柏楚电子	2,099	809,080.54	0.06
119	600380	健康元	51,315	658,884.60	0.05
120	000937	冀中能源	111,500	614,365.00	0.04
121	603589	口子窖	8,500	602,395.00	0.04
122	603719	良品铺子	14,000	594,580.00	0.04
123	000629	攀钢钒钛	135,700	527,873.00	0.04
124	688099	晶晨股份	3,404	443,200.80	0.03
125	002745	木林森	21,500	325,295.00	0.02
126	600582	天地科技	49,200	215,496.00	0.02
127	600884	杉杉股份	6,200	203,174.00	0.01
128	600988	赤峰黄金	13,400	199,660.00	0.01
129	600316	洪都航空	4,900	191,394.00	0.01
130	300463	迈克生物	1,000	29,190.00	0.00

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	825,385	21,798,417.85	1.54
2	300573	兴齐眼药	59,500	8,139,600.00	0.58
3	600887	伊利股份	188,100	7,798,626.00	0.55
4	600136	当代文体	1,047,400	7,017,580.00	0.50
5	601882	海天精工	279,900	6,933,123.00	0.49
6	603986	兆易创新	38,300	6,735,055.00	0.48
7	688030	山石网科	217,169	6,441,232.54	0.46
8	000913	钱江摩托	405,200	5,749,788.00	0.41
9	000507	珠海港	836,700	5,405,082.00	0.38
10	601666	平煤股份	609,400	5,100,678.00	0.36
11	002845	同兴达	171,000	5,053,050.00	0.36
12	300395	菲利华	73,200	4,812,168.00	0.34
13	002436	兴森科技	333,500	4,669,000.00	0.33
14	600502	安徽建工	1,113,200	4,619,780.00	0.33
15	000498	山东路桥	709,100	4,382,238.00	0.31

16	688200	华峰测控	8,107	4,149,973.30	0.29
17	002539	云图控股	309,000	4,100,430.00	0.29
18	600285	羚锐制药	258,600	4,085,880.00	0.29
19	601899	紫金矿业	395,200	3,833,440.00	0.27
20	002648	卫星化学	93,100	3,726,793.00	0.26
21	002129	中环股份	84,000	3,507,000.00	0.25
22	002533	金杯电工	396,800	3,416,448.00	0.24
23	002472	双环传动	121,600	3,353,728.00	0.24
24	600132	重庆啤酒	22,100	3,344,172.00	0.24
25	300772	运达股份	70,800	3,113,784.00	0.22
26	300723	一品红	86,700	3,112,530.00	0.22
27	600779	水井坊	25,797	3,095,382.03	0.22
28	002241	歌尔股份	54,700	2,959,270.00	0.21
29	688357	建龙微纳	14,951	2,869,694.94	0.20
30	000100	TCL 科技	451,900	2,788,223.00	0.20
31	688235	百济神州	19,217	2,777,048.67	0.20
32	600057	厦门象屿	319,500	2,712,555.00	0.19
33	300820	英杰电气	29,700	2,670,030.00	0.19
34	600116	三峡水利	226,200	2,637,492.00	0.19
35	002286	保龄宝	188,800	2,552,576.00	0.18
36	002709	天赐材料	21,742	2,492,720.30	0.18
37	300582	英飞特	107,300	2,320,899.00	0.16
38	300260	新莱应材	46,200	2,179,254.00	0.15
39	300775	三角防务	41,600	2,033,824.00	0.14
40	603886	元祖股份	86,200	2,030,010.00	0.14
41	603882	金域医学	17,666	1,967,462.42	0.14
42	600295	鄂尔多斯	82,900	1,955,611.00	0.14
43	300505	川金诺	59,400	1,820,016.00	0.13
44	600183	生益科技	75,700	1,782,735.00	0.13
45	300696	爱乐达	33,410	1,735,315.40	0.12
46	603300	华铁应急	121,800	1,638,210.00	0.12
47	300268	佳沃食品	86,500	1,603,710.00	0.11
48	603496	恒为科技	97,500	1,511,250.00	0.11
49	603599	广信股份	38,100	1,485,900.00	0.11
50	603610	麒盛科技	54,800	1,417,128.00	0.10
51	002410	广联达	20,600	1,317,988.00	0.09
52	603380	易德龙	32,441	1,242,490.30	0.09
53	301002	崧盛股份	20,500	1,102,900.00	0.08
54	688598	金博股份	2,937	1,042,752.48	0.07
55	688032	禾迈股份	1,508	981,195.28	0.07
56	300792	壹网壹创	17,740	869,260.00	0.06
57	688181	八亿时空	17,021	806,795.40	0.06
58	603612	索通发展	39,100	802,332.00	0.06

59	688798	艾为电子	3,592	755,505.36	0.05
60	300833	浩洋股份	8,600	696,858.00	0.05
61	688728	格科微	23,033	675,097.23	0.05
62	688778	厦钨新能	5,075	511,255.50	0.04
63	688151	华强科技	12,238	413,889.16	0.03
64	002330	得利斯	53,400	350,838.00	0.02
65	300680	隆盛科技	9,900	308,880.00	0.02
66	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.02
67	600882	妙可蓝多	5,300	296,800.00	0.02
68	688026	洁特生物	3,276	288,812.16	0.02
69	688558	国盛智科	5,300	239,560.00	0.02
70	300358	楚天科技	7,300	190,311.00	0.01
71	688049	炬芯科技	3,260	168,574.60	0.01
72	688121	卓然股份	3,681	134,062.02	0.01
73	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.01
74	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.01
75	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.00
76	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
77	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
78	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
79	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
80	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
81	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
82	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
83	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
84	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
85	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
86	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
87	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
88	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
89	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
90	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
91	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
92	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
93	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
94	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
95	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
96	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
97	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
98	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
99	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
100	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
101	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00

102	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
103	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
104	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
105	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
106	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
107	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
108	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
109	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
110	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
111	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
112	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
113	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
114	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
115	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
116	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
117	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
118	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
119	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
120	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
121	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
122	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
123	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
124	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
125	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
126	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
127	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
128	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
129	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
130	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
131	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
132	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
133	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
134	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
135	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
136	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
137	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
138	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
139	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
140	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
141	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
142	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
143	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
144	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

145	871245	威博液压	200	1,936.00	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600008	首创环保	57,753,348.70	21.67
2	000060	中金岭南	55,675,523.16	20.89
3	002839	张家港行	50,651,651.00	19.01
4	600885	宏发股份	50,180,881.49	18.83
5	002396	星网锐捷	48,189,377.80	18.08
6	600325	华发股份	45,532,460.00	17.09
7	002244	滨江集团	44,597,042.18	16.74
8	600373	中文传媒	43,295,486.52	16.25
9	002156	通富微电	41,271,695.32	15.49
10	600908	无锡银行	38,939,116.00	14.61
11	600282	南钢股份	38,797,365.12	14.56
12	601128	常熟银行	38,390,850.00	14.41
13	000932	华菱钢铁	38,331,737.00	14.38
14	300037	新宙邦	37,668,716.00	14.14
15	600256	广汇能源	37,654,549.94	14.13
16	601615	明阳智能	37,233,116.19	13.97
17	601598	中国外运	36,509,242.00	13.70
18	300244	迪安诊断	36,078,697.13	13.54
19	600487	亨通光电	34,678,777.00	13.01
20	601699	潞安环能	34,423,172.60	12.92
21	600597	光明乳业	34,267,420.00	12.86
22	600030	中信证券	34,256,079.55	12.86
23	002185	华天科技	34,042,081.00	12.78
24	600141	兴发集团	33,709,705.00	12.65
25	002465	海格通信	33,266,238.00	12.48
26	000887	中鼎股份	32,529,995.61	12.21
27	601636	旗滨集团	32,134,689.13	12.06
28	000717	韶钢松山	32,132,756.04	12.06
29	002557	洽洽食品	31,690,037.56	11.89
30	000039	中集集团	31,634,036.84	11.87
31	002648	卫星化学	31,515,491.12	11.83
32	600782	新钢股份	31,134,091.00	11.68
33	600765	中航重机	30,866,807.46	11.58
34	000513	丽珠集团	30,827,981.33	11.57
35	000999	华润三九	30,359,672.32	11.39
36	000630	铜陵有色	30,191,120.00	11.33

37	603444	吉比特	29,151,227.00	10.94
38	000988	华工科技	28,654,623.00	10.75
39	000598	兴蓉环境	28,612,309.56	10.74
40	600271	航天信息	28,544,502.38	10.71
41	600820	隧道股份	28,035,725.40	10.52
42	002013	中航机电	27,813,709.34	10.44
43	600502	安徽建工	27,804,522.00	10.43
44	002709	天赐材料	27,746,773.50	10.41
45	000799	酒鬼酒	27,612,829.94	10.36
46	600808	马钢股份	27,260,798.00	10.23
47	002410	广联达	26,891,149.63	10.09
48	000656	金科股份	26,817,437.00	10.06
49	600779	水井坊	26,746,188.43	10.04
50	603712	七一二	26,701,984.68	10.02
51	600089	特变电工	26,515,986.51	9.95
52	600867	通化东宝	26,219,665.00	9.84
53	600598	北大荒	26,151,882.00	9.81
54	600729	重庆百货	25,965,232.00	9.74
55	300316	晶盛机电	25,854,376.14	9.70
56	600038	中直股份	25,595,062.46	9.61
57	601689	拓普集团	25,520,044.20	9.58
58	600546	山煤国际	25,511,871.92	9.57
59	000050	深天马 A	25,220,876.20	9.46
60	002048	宁波华翔	25,059,765.89	9.40
61	300253	卫宁健康	24,879,572.48	9.34
62	601555	东吴证券	24,797,383.46	9.31
63	601928	凤凰传媒	24,606,840.00	9.23
64	000990	诚志股份	24,402,970.00	9.16
65	600549	厦门钨业	24,261,357.05	9.10
66	600500	中化国际	23,752,664.40	8.91
67	000671	阳光城	23,629,019.25	8.87
68	000830	鲁西化工	23,591,303.00	8.85
69	300271	华宇软件	23,433,856.60	8.79
70	600803	新奥股份	23,214,502.18	8.71
71	000636	风华高科	23,184,715.04	8.70
72	601233	桐昆股份	23,047,461.00	8.65
73	688099	晶晨股份	22,978,922.73	8.62
74	000498	山东路桥	22,716,674.58	8.52
75	000807	云铝股份	22,570,964.72	8.47
76	000825	太钢不锈	22,567,302.00	8.47
77	000898	鞍钢股份	22,347,461.40	8.39
78	300630	普利制药	22,313,790.00	8.37

79	000987	越秀金控	22,307,669.10	8.37
80	002382	蓝帆医疗	22,183,091.22	8.32
81	002439	启明星辰	22,035,081.88	8.27
82	603882	金域医学	22,007,755.40	8.26
83	002458	益生股份	21,915,729.05	8.22
84	300474	景嘉微	21,882,014.00	8.21
85	603456	九洲药业	21,769,847.00	8.17
86	601098	中南传媒	21,754,296.55	8.16
87	603486	科沃斯	21,062,185.00	7.90
88	600862	中航高科	21,025,031.00	7.89
89	002317	众生药业	20,743,021.44	7.78
90	000937	冀中能源	20,269,666.00	7.61
91	002080	中材科技	20,194,667.56	7.58
92	000960	锡业股份	20,176,753.73	7.57
93	000009	中国宝安	20,142,855.53	7.56
94	600132	重庆啤酒	20,092,750.02	7.54
95	600372	中航电子	20,049,981.40	7.52
96	600066	宇通客车	19,931,945.00	7.48
97	603225	新风鸣	19,643,215.48	7.37
98	600970	中材国际	19,597,283.00	7.35
99	600529	山东药玻	19,470,640.00	7.31
100	002701	奥瑞金	19,365,977.00	7.27
101	000738	航发控制	19,305,180.65	7.24
102	600064	南京高科	19,287,201.15	7.24
103	600884	杉杉股份	19,253,951.18	7.23
104	600201	生物股份	19,064,272.68	7.15
105	300395	菲利华	18,804,952.78	7.06
106	600153	建发股份	18,756,723.39	7.04
107	000877	天山股份	18,659,487.00	7.00
108	600380	健康元	18,551,123.85	6.96
109	002043	兔宝宝	18,442,039.77	6.92
110	300207	欣旺达	18,351,401.08	6.89
111	300122	智飞生物	18,313,100.00	6.87
112	300168	万达信息	18,264,854.00	6.85
113	600329	中新药业	18,050,336.51	6.77
114	000528	柳工	17,952,384.42	6.74
115	002056	横店东磁	17,681,971.98	6.64
116	000501	鄂武商 A	17,641,285.27	6.62
117	000526	学大教育	17,571,559.00	6.59
118	300363	博腾股份	17,549,820.00	6.59
119	300463	迈克生物	17,463,011.00	6.55
120	000012	南玻 A	17,333,331.78	6.50

121	002223	鱼跃医疗	17,328,911.44	6.50
122	300058	蓝色光标	17,303,771.00	6.49
123	002266	浙富控股	17,239,311.30	6.47
124	000959	首钢股份	17,146,475.00	6.43
125	300223	北京君正	17,056,421.81	6.40
126	600136	当代文体	17,040,148.00	6.39
127	688005	容百科技	16,996,964.78	6.38
128	601168	西部矿业	16,964,216.00	6.37
129	600426	华鲁恒升	16,930,272.40	6.35
130	600348	华阳股份	16,929,638.00	6.35
131	600155	华创阳安	16,866,899.61	6.33
132	600315	上海家化	16,835,233.41	6.32
133	601577	长沙银行	16,816,926.92	6.31
134	601717	郑煤机	16,573,975.00	6.22
135	002946	新乳业	16,388,351.00	6.15
136	300662	科锐国际	16,368,567.72	6.14
137	600039	四川路桥	16,329,109.00	6.13
138	603883	老百姓	16,299,810.00	6.12
139	600536	中国软件	15,945,854.95	5.98
140	600219	南山铝业	15,861,526.00	5.95
141	601881	中国银河	15,821,273.48	5.94
142	600388	龙净环保	15,686,215.00	5.89
143	002030	达安基因	15,589,262.12	5.85
144	603260	合盛硅业	15,114,220.00	5.67
145	603927	中科软	15,088,550.60	5.66
146	601958	金钼股份	14,950,178.00	5.61
147	600511	国药股份	14,906,231.00	5.59
148	000725	京东方 A	14,830,668.00	5.57
149	600415	小商品城	14,819,482.00	5.56
150	002074	国轩高科	14,764,174.00	5.54
151	000100	TCL 科技	14,741,621.00	5.53
152	600316	洪都航空	14,689,902.94	5.51
153	000581	威孚高科	14,583,994.00	5.47
154	300146	汤臣倍健	14,491,852.98	5.44
155	002511	中顺洁柔	14,486,534.27	5.44
156	002273	水晶光电	14,469,670.57	5.43
157	002985	北摩高科	14,451,097.80	5.42
158	603056	德邦股份	14,346,714.52	5.38
159	600183	生益科技	14,258,214.00	5.35
160	002408	齐翔腾达	14,205,770.36	5.33
161	600998	九州通	14,144,791.00	5.31
162	002436	兴森科技	14,142,314.94	5.31

163	002508	老板电器	14,001,292.72	5.25
164	600643	爱建集团	13,885,434.29	5.21
165	600409	三友化工	13,869,940.00	5.21
166	000983	山西焦煤	13,795,329.08	5.18
167	600580	卧龙电驱	13,718,935.19	5.15
168	688030	山石网科	13,672,133.23	5.13
169	002368	太极股份	13,384,215.00	5.02
170	600460	士兰微	13,362,926.00	5.01
171	002124	天邦股份	13,349,235.60	5.01
172	600563	法拉电子	13,277,865.68	4.98
173	601375	中原证券	13,185,146.00	4.95
174	300573	兴齐眼药	13,117,828.00	4.92
175	300783	三只松鼠	13,031,692.00	4.89
176	000629	攀钢钒钛	12,963,547.00	4.86
177	002064	华峰化学	12,885,257.00	4.84
178	600901	江苏租赁	12,755,977.00	4.79
179	603727	博迈科	12,727,413.33	4.78
180	002603	以岭药业	12,669,116.55	4.75
181	601678	滨化股份	12,612,294.00	4.73
182	603198	迎驾贡酒	12,555,427.37	4.71
183	300418	昆仑万维	12,552,816.00	4.71
184	601000	唐山港	12,511,880.12	4.70
185	600057	厦门象屿	12,505,361.00	4.69
186	600123	兰花科创	12,490,174.00	4.69
187	601005	重庆钢铁	12,447,382.00	4.67
188	600967	内蒙一机	12,337,462.00	4.63
189	002286	保龄宝	12,315,899.00	4.62
190	002375	亚厦股份	12,285,296.00	4.61
191	603337	杰克股份	12,194,350.00	4.58
192	603613	国联股份	12,164,625.86	4.57
193	000733	振华科技	12,114,965.00	4.55
194	002191	劲嘉股份	12,049,035.00	4.52
195	002128	电投能源	11,792,378.00	4.43
196	603010	万盛股份	11,759,981.50	4.41
197	603186	华正新材	11,581,669.99	4.35
198	002281	光迅科技	11,493,243.80	4.31
199	300101	振芯科技	11,475,796.26	4.31
200	002183	怡亚通	11,414,280.80	4.28
201	603605	珀莱雅	11,288,718.00	4.24
202	002690	美亚光电	11,259,037.00	4.23
203	600764	中国海防	11,256,681.00	4.22
204	000519	中兵红箭	11,255,700.00	4.22

205	601666	平煤股份	11,148,715.00	4.18
206	300033	同花顺	11,116,802.12	4.17
207	600298	安琪酵母	11,087,056.00	4.16
208	300059	东方财富	11,050,568.21	4.15
209	002683	广东宏大	11,003,688.50	4.13
210	002845	同兴达	10,976,800.00	4.12
211	600188	兖矿能源	10,795,526.00	4.05
212	300138	晨光生物	10,793,630.00	4.05
213	600728	佳都科技	10,700,407.00	4.02
214	000507	珠海港	10,671,834.00	4.00
215	600823	世茂股份	10,645,357.00	3.99
216	002138	顺络电子	10,644,848.00	3.99
217	002635	安洁科技	10,555,892.00	3.96
218	002129	中环股份	10,527,579.00	3.95
219	300751	迈为股份	10,427,752.85	3.91
220	600887	伊利股份	10,340,156.00	3.88
221	000739	普洛药业	10,295,022.20	3.86
222	000970	中科三环	10,158,892.00	3.81
223	002966	苏州银行	10,138,173.00	3.80
224	300696	爱乐达	10,125,602.10	3.80
225	603599	广信股份	10,046,016.06	3.77
226	300639	凯普生物	9,813,333.06	3.68
227	600699	均胜电子	9,805,938.00	3.68
228	605358	立昂微	9,772,456.00	3.67
229	601211	国泰君安	9,700,190.00	3.64
230	000818	航锦科技	9,634,150.00	3.62
231	002092	中泰化学	9,534,256.00	3.58
232	601003	柳钢股份	9,521,392.81	3.57
233	600710	苏美达	9,439,422.00	3.54
234	600170	上海建工	9,341,053.00	3.51
235	603612	索通发展	9,317,778.00	3.50
236	600835	上海机电	9,226,480.00	3.46
237	002028	思源电气	9,216,100.41	3.46
238	600323	瀚蓝环境	9,168,129.00	3.44
239	603737	三棵树	9,158,356.40	3.44
240	600966	博汇纸业	9,116,695.00	3.42
241	601339	百隆东方	8,969,297.00	3.37
242	300465	高伟达	8,917,875.00	3.35
243	002777	久远银海	8,800,777.42	3.30
244	600392	盛和资源	8,796,257.00	3.30
245	002332	仙琚制药	8,757,649.00	3.29
246	600285	羚锐制药	8,637,470.00	3.24

247	600195	中牧股份	8,513,953.21	3.20
248	002831	裕同科技	8,508,300.00	3.19
249	601117	中国化学	8,372,465.00	3.14
250	601878	浙商证券	8,327,235.00	3.13
251	300755	华致酒行	8,287,900.95	3.11
252	688200	华峰测控	8,185,382.87	3.07
253	300482	万孚生物	8,160,485.54	3.06
254	000488	晨鸣纸业	8,131,415.00	3.05
255	600060	海信视像	8,118,629.00	3.05
256	601016	节能风电	8,037,356.00	3.02
257	603986	兆易创新	7,989,104.58	3.00
258	600166	福田汽车	7,977,585.00	2.99
259	300820	英杰电气	7,948,408.50	2.98
260	300775	三角防务	7,917,967.50	2.97
261	600859	王府井	7,875,934.40	2.96
262	600705	中航产融	7,825,640.00	2.94
263	000913	钱江摩托	7,747,270.00	2.91
264	300705	九典制药	7,717,745.50	2.90
265	601882	海天精工	7,711,244.00	2.89
266	002643	万润股份	7,681,231.91	2.88
267	002961	瑞达期货	7,671,628.50	2.88
268	002430	杭氧股份	7,550,948.00	2.83
269	002110	三钢闽光	7,538,921.00	2.83
270	600027	华电国际	7,519,598.66	2.82
271	300496	中科创达	7,462,097.00	2.80
272	002539	云图控股	7,416,099.00	2.78
273	300618	寒锐钴业	7,408,991.00	2.78
274	300182	捷成股份	7,351,763.00	2.76
275	601001	晋控煤业	7,347,973.38	2.76
276	600707	彩虹股份	7,346,931.00	2.76
277	600742	一汽富维	7,333,486.60	2.75
278	002572	索菲亚	7,329,617.00	2.75
279	603979	金诚信	7,312,068.80	2.74
280	300010	豆神教育	7,264,030.00	2.73
281	688026	洁特生物	7,259,917.70	2.72
282	001914	招商积余	7,229,224.98	2.71
283	002254	泰和新材	7,128,841.22	2.68
284	603678	火炬电子	7,106,492.00	2.67
285	600582	天地科技	7,071,799.00	2.65
286	603799	华友钴业	7,053,920.00	2.65
287	600176	中国巨石	6,990,070.61	2.62
288	600971	恒源煤电	6,981,090.80	2.62

289	002299	圣农发展	6,934,687.00	2.60
290	300224	正海磁材	6,904,000.00	2.59
291	600704	物产中大	6,871,658.00	2.58
292	002637	赞宇科技	6,805,838.00	2.55
293	601899	紫金矿业	6,790,205.00	2.55
294	688006	杭可科技	6,782,442.32	2.55
295	601200	上海环境	6,771,918.00	2.54
296	300723	一品红	6,720,366.00	2.52
297	603589	口子窖	6,676,541.00	2.51
298	600216	浙江医药	6,641,260.00	2.49
299	002065	东华软件	6,609,598.00	2.48
300	603606	东方电缆	6,576,271.34	2.47
301	002212	天融信	6,531,203.00	2.45
302	603377	东方时尚	6,466,381.00	2.43
303	603300	华铁应急	6,465,434.80	2.43
304	002078	太阳纸业	6,446,641.00	2.42
305	300260	新莱应材	6,435,800.00	2.42
306	300133	华策影视	6,411,729.00	2.41
307	600116	三峡水利	6,278,961.00	2.36
308	600642	申能股份	6,257,417.69	2.35
309	600988	赤峰黄金	6,191,235.00	2.32
310	002416	爱施德	6,153,251.00	2.31
311	601336	新华保险	6,058,366.00	2.27
312	600497	驰宏锌锗	6,012,316.81	2.26
313	300012	华测检测	5,993,792.00	2.25
314	002390	信邦制药	5,946,928.00	2.23
315	688357	建龙微纳	5,928,570.07	2.22
316	300833	浩洋股份	5,890,804.00	2.21
317	603886	元祖股份	5,886,739.00	2.21
318	600895	张江高科	5,871,185.00	2.20
319	601918	新集能源	5,817,565.00	2.18
320	603855	华荣股份	5,812,200.00	2.18
321	600171	上海贝岭	5,781,604.90	2.17
322	000933	神火股份	5,733,629.00	2.15
323	002745	木林森	5,720,919.00	2.15
324	300319	麦捷科技	5,713,833.00	2.14
325	600376	首开股份	5,672,882.00	2.13
326	600875	东方电气	5,666,468.00	2.13
327	688181	八亿时空	5,569,964.50	2.09
328	603893	瑞芯微	5,463,596.00	2.05
329	002422	科伦药业	5,356,434.00	2.01

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002839	张家港行	50,430,044.79	18.93
2	601615	明阳智能	44,492,844.62	16.70
3	002244	滨江集团	38,854,481.06	14.58
4	600008	首创环保	38,571,520.00	14.47
5	002013	中航机电	34,224,012.22	12.84
6	600141	兴发集团	32,787,691.00	12.30
7	000630	铜陵有色	32,149,045.00	12.06
8	000887	中鼎股份	32,085,604.37	12.04
9	600089	特变电工	31,872,445.37	11.96
10	600256	广汇能源	31,817,563.11	11.94
11	600908	无锡银行	30,442,924.00	11.42
12	000513	丽珠集团	29,617,114.00	11.11
13	300316	晶盛机电	29,060,300.34	10.91
14	600779	水井坊	29,021,512.00	10.89
15	002709	天赐材料	28,597,795.84	10.73
16	000717	韶钢松山	28,416,518.62	10.66
17	601636	旗滨集团	28,365,197.40	10.64
18	000799	酒鬼酒	27,441,251.16	10.30
19	002080	中材科技	27,168,893.16	10.20
20	002648	卫星化学	27,166,346.20	10.19
21	002048	宁波华翔	26,844,636.39	10.07
22	000937	冀中能源	26,835,469.50	10.07
23	600884	杉杉股份	26,140,124.31	9.81
24	000999	华润三九	26,038,096.00	9.77
25	600325	华发股份	25,953,301.40	9.74
26	002410	广联达	25,556,368.00	9.59
27	600820	隧道股份	25,408,627.50	9.54
28	600598	北大荒	25,169,408.00	9.45
29	300207	欣旺达	25,155,492.76	9.44
30	002465	海格通信	24,972,918.44	9.37
31	002056	横店东磁	24,783,986.88	9.30
32	300244	迪安诊断	24,748,450.12	9.29
33	600782	新钢股份	24,556,254.80	9.22
34	000932	华菱钢铁	24,516,476.91	9.20
35	688099	晶晨股份	24,508,399.08	9.20
36	000738	航发控制	24,296,120.18	9.12
37	601928	凤凰传媒	24,278,610.98	9.11

38	002382	蓝帆医疗	23,817,951.95	8.94
39	600729	重庆百货	23,702,596.69	8.89
40	600502	安徽建工	23,539,251.58	8.83
41	000060	中金岭南	23,420,903.47	8.79
42	000898	鞍钢股份	23,170,806.00	8.70
43	603486	科沃斯	23,006,235.49	8.63
44	002458	益生股份	22,753,005.50	8.54
45	603882	金域医学	22,669,817.49	8.51
46	600153	建发股份	22,650,751.07	8.50
47	600039	四川路桥	22,489,223.85	8.44
48	600372	中航电子	22,441,310.00	8.42
49	002396	星网锐捷	21,937,605.00	8.23
50	000807	云铝股份	21,887,036.08	8.21
51	300474	景嘉微	21,819,339.00	8.19
52	300630	普利制药	21,775,914.82	8.17
53	300271	华宇软件	21,562,674.84	8.09
54	002185	华天科技	21,408,741.00	8.03
55	600549	厦门钨业	21,100,940.00	7.92
56	002317	众生药业	21,025,244.76	7.89
57	600885	宏发股份	20,975,216.00	7.87
58	000581	威孚高科	20,966,936.06	7.87
59	600500	中化国际	20,905,576.96	7.85
60	000050	深天马 A	20,771,099.95	7.79
61	600282	南钢股份	20,656,256.00	7.75
62	601233	桐昆股份	20,350,067.46	7.64
63	601128	常熟银行	20,298,314.00	7.62
64	600132	重庆啤酒	20,288,416.00	7.61
65	300058	蓝色光标	20,205,379.25	7.58
66	000990	诚志股份	20,105,249.00	7.54
67	601098	中南传媒	20,104,105.46	7.54
68	600765	中航重机	20,037,367.15	7.52
69	600597	光明乳业	19,870,757.23	7.46
70	002266	浙富控股	19,757,715.15	7.41
71	600380	健康元	19,465,327.88	7.30
72	000498	山东路桥	19,411,105.46	7.28
73	603712	七一二	19,290,425.27	7.24
74	600066	宇通客车	19,256,578.55	7.23
75	600038	中直股份	19,004,646.73	7.13
76	600426	华鲁恒升	18,688,262.20	7.01
77	002030	达安基因	18,657,973.79	7.00
78	000671	阳光城	18,362,427.22	6.89
79	000877	天山股份	18,211,204.69	6.83

80	300146	汤臣倍健	18,095,573.14	6.79
81	000012	南玻 A	17,859,783.08	6.70
82	601689	拓普集团	17,731,070.00	6.65
83	002701	奥瑞金	17,595,574.80	6.60
84	000528	柳工	17,386,258.36	6.52
85	002557	洽洽食品	17,379,509.63	6.52
86	002043	兔宝宝	17,372,390.50	6.52
87	000636	风华高科	17,333,936.00	6.50
88	002946	新乳业	17,258,106.45	6.48
89	600867	通化东宝	17,182,422.48	6.45
90	000501	鄂武商 A	16,898,388.42	6.34
91	600409	三友化工	16,882,680.58	6.34
92	300168	万达信息	16,813,724.10	6.31
93	603883	老百姓	16,716,861.37	6.27
94	300662	科锐国际	16,700,362.92	6.27
95	600348	华阳股份	16,578,543.30	6.22
96	600970	中材国际	16,572,372.84	6.22
97	000825	太钢不锈	16,547,753.00	6.21
98	600373	中文传媒	16,514,195.01	6.20
99	300395	菲利华	16,317,435.00	6.12
100	601881	中国银河	16,311,411.38	6.12
101	600155	华创阳安	16,082,852.00	6.04
102	300463	迈克生物	16,068,468.76	6.03
103	603225	新凤鸣	16,057,776.77	6.03
104	600064	南京高科	15,902,247.84	5.97
105	601000	唐山港	15,893,103.12	5.96
106	002064	华峰化学	15,884,767.00	5.96
107	600271	航天信息	15,763,926.00	5.92
108	002273	水晶光电	15,592,109.24	5.85
109	000830	鲁西化工	15,587,642.68	5.85
110	002408	齐翔腾达	15,468,116.00	5.80
111	601577	长沙银行	15,408,800.68	5.78
112	600388	龙净环保	15,356,291.89	5.76
113	000526	学大教育	15,346,496.00	5.76
114	601168	西部矿业	15,340,352.53	5.76
115	600219	南山铝业	15,335,630.00	5.76
116	603260	合盛硅业	15,334,970.00	5.75
117	300122	智飞生物	15,175,462.00	5.69
118	600460	士兰微	15,139,169.00	5.68
119	300101	振芯科技	15,093,936.04	5.66
120	002439	启明星辰	15,063,300.00	5.65
121	002074	国轩高科	15,054,639.00	5.65

122	002138	顺络电子	14,821,715.16	5.56
123	603010	万盛股份	14,785,576.40	5.55
124	600316	洪都航空	14,634,984.49	5.49
125	000598	兴蓉环境	14,582,377.00	5.47
126	601717	郑煤机	14,575,629.00	5.47
127	000959	首钢股份	14,542,294.00	5.46
128	601958	金钼股份	14,538,308.00	5.46
129	603444	吉比特	14,417,578.00	5.41
130	600123	兰花科创	14,386,238.00	5.40
131	601678	滨化股份	14,291,342.66	5.36
132	603198	迎驾贡酒	14,099,954.57	5.29
133	600803	新奥股份	14,073,624.00	5.28
134	600580	卧龙电驱	14,045,847.63	5.27
135	603056	德邦股份	13,956,768.64	5.24
136	000725	京东方 A	13,835,742.00	5.19
137	300223	北京君正	13,807,475.89	5.18
138	000656	金科股份	13,690,169.00	5.14
139	600536	中国软件	13,659,094.00	5.13
140	002603	以岭药业	13,525,682.96	5.08
141	603727	博迈科	13,504,338.36	5.07
142	601699	潞安环能	13,396,273.00	5.03
143	600643	爱建集团	13,385,373.50	5.02
144	002368	太极股份	13,204,988.69	4.96
145	600030	中信证券	13,095,896.00	4.91
146	600315	上海家化	13,083,943.99	4.91
147	300783	三只松鼠	13,069,931.00	4.90
148	002281	光迅科技	12,915,411.89	4.85
149	601375	中原证券	12,869,850.00	4.83
150	002156	通富微电	12,724,047.00	4.78
151	300253	卫宁健康	12,723,451.00	4.77
152	002191	劲嘉股份	12,713,494.72	4.77
153	002683	广东宏大	12,661,877.92	4.75
154	000629	攀钢钒钛	12,592,010.00	4.73
155	002128	电投能源	12,586,385.40	4.72
156	600967	内蒙一机	12,542,730.00	4.71
157	002124	天邦股份	12,533,256.60	4.70
158	603186	华正新材	12,530,727.00	4.70
159	600201	生物股份	12,522,409.44	4.70
160	600511	国药股份	12,518,005.00	4.70
161	600808	马钢股份	12,450,324.00	4.67
162	600329	中新药业	12,434,318.20	4.67
163	002183	怡亚通	12,402,832.20	4.65

164	600998	九州通	12,401,716.00	4.65
165	000983	山西焦煤	12,306,274.90	4.62
166	000100	TCL 科技	11,897,310.52	4.46
167	002635	安洁科技	11,895,040.23	4.46
168	000970	中科三环	11,753,557.00	4.41
169	000039	中集集团	11,659,010.04	4.38
170	300138	晨光生物	11,658,581.00	4.38
171	300418	昆仑万维	11,624,516.00	4.36
172	600529	山东药玻	11,474,499.00	4.31
173	603337	杰克股份	11,359,710.00	4.26
174	300037	新宙邦	11,326,560.00	4.25
175	600183	生益科技	11,272,670.00	4.23
176	000739	普洛药业	11,235,960.80	4.22
177	600901	江苏租赁	11,227,896.00	4.21
178	601005	重庆钢铁	11,206,611.00	4.21
179	601211	国泰君安	11,143,843.72	4.18
180	002511	中顺洁柔	11,126,893.79	4.18
181	600136	当代文体	11,104,245.00	4.17
182	601598	中国外运	10,967,500.42	4.12
183	300059	东方财富	10,795,082.93	4.05
184	600862	中航高科	10,694,154.00	4.01
185	300496	中科创达	10,641,640.94	3.99
186	002092	中泰化学	10,619,133.80	3.99
187	000818	航锦科技	10,578,463.00	3.97
188	600728	佳都科技	10,549,923.00	3.96
189	002436	兴森科技	10,195,264.98	3.83
190	002286	保龄宝	10,072,854.00	3.78
191	600057	厦门象屿	10,034,885.00	3.77
192	300033	同花顺	9,923,937.00	3.72
193	600823	世茂股份	9,902,498.00	3.72
194	002966	苏州银行	9,751,179.00	3.66
195	600188	兖矿能源	9,743,577.00	3.66
196	600710	苏美达	9,596,657.00	3.60
197	600546	山煤国际	9,574,166.37	3.59
198	300274	阳光电源	9,553,498.00	3.59
199	000690	宝新能源	9,497,411.00	3.56
200	603612	索通发展	9,410,845.00	3.53
201	300639	凯普生物	9,346,255.64	3.51
202	603599	广信股份	9,332,415.00	3.50
203	600742	一汽富维	9,292,792.46	3.49
204	000987	越秀金控	9,281,960.00	3.48
205	600835	上海机电	9,191,268.00	3.45

206	002985	北摩高科	9,175,663.82	3.44
207	603737	三棵树	9,050,421.00	3.40
208	002643	万润股份	9,035,987.81	3.39
209	600699	均胜电子	8,976,213.00	3.37
210	601878	浙商证券	8,849,590.00	3.32
211	601003	柳钢股份	8,827,814.80	3.31
212	300755	华致酒行	8,827,051.36	3.31
213	601117	中国化学	8,773,355.00	3.29
214	002777	久远银海	8,766,154.83	3.29
215	002223	鱼跃医疗	8,708,070.00	3.27
216	300465	高伟达	8,669,484.00	3.25
217	600323	瀚蓝环境	8,652,394.00	3.25
218	600966	博汇纸业	8,634,091.00	3.24
219	601339	百隆东方	8,598,679.00	3.23
220	300182	捷成股份	8,591,924.00	3.22
221	603456	九洲药业	8,461,785.00	3.18
222	600563	法拉电子	8,351,054.60	3.13
223	002572	索菲亚	8,338,823.23	3.13
224	603678	火炬电子	8,323,553.00	3.12
225	000960	锡业股份	8,197,984.00	3.08
226	002332	仙琚制药	8,165,946.00	3.06
227	600060	海信视像	8,128,399.00	3.05
228	600195	中牧股份	8,098,114.95	3.04
229	600859	王府井	8,037,880.54	3.02
230	600170	上海建工	7,990,759.00	3.00
231	002961	瑞达期货	7,947,911.40	2.98
232	300696	爱乐达	7,886,569.00	2.96
233	600166	福田汽车	7,758,483.00	2.91
234	001914	招商积余	7,732,749.00	2.90
235	000600	建投能源	7,725,951.50	2.90
236	000519	中兵红箭	7,654,924.00	2.87
237	300618	寒锐钴业	7,652,764.63	2.87
238	688030	山石网科	7,619,149.29	2.86
239	601001	晋控煤业	7,579,473.30	2.84
240	000488	晨鸣纸业	7,565,649.00	2.84
241	603979	金诚信	7,495,531.32	2.81
242	600487	亨通光电	7,423,417.00	2.79
243	002690	美亚光电	7,363,006.64	2.76
244	002375	亚厦股份	7,333,871.00	2.75
245	601016	节能风电	7,305,494.00	2.74
246	603606	东方电缆	7,286,403.00	2.73
247	002745	木林森	7,275,226.46	2.73

248	002299	圣农发展	7,217,872.02	2.71
249	002254	泰和新材	7,214,767.00	2.71
250	002110	三钢闽光	7,147,158.00	2.68
251	300482	万孚生物	7,111,221.00	2.67
252	600176	中国巨石	7,107,792.98	2.67
253	600582	天地科技	7,051,924.00	2.65
254	600418	江淮汽车	7,037,863.67	2.64
255	600216	浙江医药	7,030,608.00	2.64
256	000988	华工科技	6,991,459.00	2.62
257	002212	天融信	6,972,020.00	2.62
258	603589	口子窖	6,970,164.00	2.62
259	300010	豆神教育	6,956,286.16	2.61
260	600027	华电国际	6,940,485.27	2.60
261	600707	彩虹股份	6,876,388.00	2.58
262	002129	中环股份	6,868,558.27	2.58
263	600642	申能股份	6,858,234.75	2.57
264	600704	物产中大	6,806,677.00	2.55
265	300573	兴齐眼药	6,804,272.00	2.55
266	300224	正海磁材	6,785,888.00	2.55
267	600971	恒源煤电	6,756,932.32	2.54
268	688026	洁特生物	6,715,853.18	2.52
269	603799	华友钴业	6,689,680.66	2.51
270	300705	九典制药	6,675,654.25	2.51
271	601200	上海环境	6,521,758.67	2.45
272	300133	华策影视	6,466,747.00	2.43
273	601666	平煤股份	6,417,565.00	2.41
274	300820	英杰电气	6,388,388.00	2.40
275	002637	赞宇科技	6,363,418.00	2.39
276	002065	东华软件	6,362,622.00	2.39
277	600875	东方电气	6,259,225.24	2.35
278	002645	华宏科技	6,215,255.11	2.33
279	000951	中国重汽	6,191,099.00	2.32
280	000009	中国宝安	6,153,089.56	2.31
281	002845	同兴达	6,146,860.00	2.31
282	300319	麦捷科技	6,063,096.00	2.28
283	002390	信邦制药	6,035,202.00	2.26
284	603855	华荣股份	5,999,613.00	2.25
285	300012	华测检测	5,954,992.00	2.23
286	603377	东方时尚	5,925,601.80	2.22
287	300775	三角防务	5,900,390.00	2.21
288	600988	赤峰黄金	5,890,692.48	2.21
289	600507	方大特钢	5,829,211.05	2.19

290	600895	张江高科	5,814,518.00	2.18
291	002078	太阳纸业	5,777,033.00	2.17
292	600497	驰宏锌锗	5,760,824.00	2.16
293	603901	永创智能	5,740,970.00	2.15
294	002028	思源电气	5,710,711.58	2.14
295	600171	上海贝岭	5,705,475.31	2.14
296	000933	神火股份	5,702,939.00	2.14
297	603267	鸿远电子	5,644,663.68	2.12
298	600285	羚锐制药	5,589,395.00	2.10
299	600392	盛和资源	5,477,757.00	2.06
300	600740	山西焦化	5,471,555.88	2.05
301	000026	飞亚达	5,448,453.00	2.04
302	688005	容百科技	5,388,164.91	2.02
303	600732	爱旭股份	5,342,445.00	2.00
304	601918	新集能源	5,341,018.65	2.00

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,105,126,803.71
卖出股票收入（成交）总额	5,150,686,791.52

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	63,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	63,000.00	0.00

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产
----	------	------	-------	------	-------

					净值比例(%)
1	113634	珀莱转债	630	63,000.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2203	中证 500 股指期货 2203	10	14,611,600.00	615,520.00	根据公募基金相关法规和本基金合同,我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间,股指期货仍然贴水,我们选择保持一定比例的股指期货多头,获取比较确定的超额收益。
公允价值变动总额合计 (元)					615,520.00
股指期货投资本期收益 (元)					1,423,271.20
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					615,520.00

注: 买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用, 降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定, 本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定, 本基金投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、通富微电子股份有限公司（以下简称“通富微电”，股票代码：002156）于 2021 年 1 月 28 日收到中华人民共和国上海浦东国际机场海关出具的行政处罚决定（沪浦机关缉违字[2021]0015 号），其因委托上海伟奕国际货运代理有限公司，申报的进口货物数量与实际进口数量不符，构成违反海关监管规定的行为，被处罚款共计人民币 20000 元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对通富微电进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,545,155.35
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	13,803.94
5	应收申购款	4,574,421.33
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,133,380.62

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
166,790	5,193.03	428,526,266.38	49.48	437,619,510.34	50.52

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	154,972.00	0.017892

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 3 月 25 日) 基金份额总额	1,508,879,568.71
本报告期期初基金份额总额	199,630,692.21
本报告期基金总申购份额	1,460,924,998.43
减：本报告期基金总赎回份额	794,409,913.92
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	866,145,776.72

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本管理人于 2021 年 3 月 30 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任刘彦春先生担任本公司副总经理。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 3 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 100,000.00 元

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券股份有限公司	2	1,843,272,982.59	16.43%	1,716,665.39	16.46%	-
东吴证券	1	1,682,429,105.51	14.99%	1,566,851.81	15.03%	-

股份有限 公司						
长城证券 股份有限 公司	3	1,622,534,315.23	14.46%	1,511,063.44	14.49%	本期 新增 1 个
中信建投 证券股份 有限公司	2	983,119,355.00	8.76%	915,590.21	8.78%	-
华泰证券 股份有限 公司	1	896,440,627.40	7.99%	834,846.75	8.01%	-
中泰证券 股份有限 公司	1	875,350,733.49	7.80%	815,217.66	7.82%	-
广发证券 股份有限 公司	2	765,383,140.19	6.82%	712,803.85	6.84%	-
海通证券 股份有限 公司	3	746,319,479.44	6.65%	695,040.81	6.67%	-
浙商证券 股份有限 公司	1	417,660,309.24	3.72%	388,966.49	3.73%	-
招商证券 股份有限 公司	2	382,456,398.06	3.41%	356,190.44	3.42%	-
华西证券 股份有限 公司	1	255,152,577.84	2.27%	237,623.83	2.28%	-
国盛证券	1	180,922,244.94	1.61%	168,496.24	1.62%	-

有限责任 公司						
平安证券 股份有限 公司	1	175,471,655.85	1.56%	163,418.37	1.57%	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	164,574,608.13	1.47%	153,270.91	1.47%	-
中信证券 股份有限 公司	2	109,958,313.32	0.98%	80,414.28	0.77%	本期 新增 1 个
东兴证券 股份有限 公司	1	74,652,639.93	0.67%	69,523.84	0.67%	-
信达证券 股份有限 公司	1	41,743,610.75	0.37%	38,876.31	0.37%	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	3,007,933.48	0.03%	2,801.47	0.03%	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	57,841.00	3.48%	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	105,990.60	6.37%	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	125,993.70	7.57%	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
国盛证券 有限责任 公司	1,373,797.20	82.58%	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
3	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统招行直联渠道基金交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
4	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-05
7	景顺长城基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09
8	关于旗下部分基金新增国联证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加申购、定	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-18

	期定额投资申购费率优惠的公告		
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
10	关于旗下部分基金新增东吴证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-01
11	关于旗下部分基金新增恒天明泽为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-05
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-15
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-20
15	关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-25
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
18	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
19	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
20	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同(基金合同更新)	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
21	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
23	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2021-04-02

	停机维护的公告	网站	
25	关于景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金在华鑫证券开通基金定期定额投资业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
26	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-12
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
28	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19
29	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
31	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
32	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
33	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
34	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-20
35	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
36	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
37	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
38	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
39	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
40	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
41	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-09
42	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-13
43	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-16
44	关于旗下部分基金新增首创证券股份有限公司为销售机构并开通基金“定	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-20

	期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告		
45	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-20
46	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
47	关于景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金新增招商银行股份有限公司招赢通平台为销售平台及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
48	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
49	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-23
50	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-27
51	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-06
52	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增晋商银行作为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-11
53	关于景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金新增东莞农村商业银行股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-18
54	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-20
55	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
56	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
57	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-27
58	关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-03
59	景顺长城基金将积极参与投资北京证券交易所上市企业	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-07
60	关于旗下部分基金新增招商银行为销售机构并开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-10

61	关于景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金新增中国银河证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-23
62	关于景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金新增华泰证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-28
63	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-15
64	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-15
65	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-22
66	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
67	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
68	关于旗下部分基金新增太平洋证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-10
69	景顺长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票的风险提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-16
70	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-18
71	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 3 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-30
72	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-30
73	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-03
74	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-10
75	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-16
76	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-17
77	关于旗下部分基金新增泰信财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-24

	定额投资申购费率优惠的公告		
78	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-24
79	景顺长城基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-29

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，我司对旗下包括本基金在内的 15 只基金的基金合同等法律文件进行修订。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2021 年 3 月 29 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

2、根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及本基金基金合同等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定对本基金的基金合同等法律文件进行修订，新增侧袋机制相关内容。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2021 年 6 月 18 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 6 月 18 日发布的相关公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2022 年 3 月 28 日